

Домашнее задание по эконометрике для группы Э_Б2018_Э_3 №2 (часть 4), 2020-2021

Используйте волну RLMS выделенного Вам года (ту же, что в заданиях 2.2, 2.3), данные об индивидах или домохозяйствах (предпочтительнее, там больше информации о семье).

Выберите одну непрерывную зависимую переменную, например, о доходе индивида в соответствующем году.

- 1) Выберите (при необходимости создайте) необходимые объясняющие переменные.
- 2) Среди Ваших регрессоров скорее всего те, которые могут оказаться эндогенными (например, уровень образования).
- 3) Постарайтесь найти подходящие инструменты для эндогенных регрессоров (например, какие-то переменные для членов их семьи).
- 4) Проверьте качество выбранных инструментов (релевантность и валидность).
Проведите тесты Хаусмана, Дарбина-Ву-Хаусмана, Саргана (или Хансена). Если инструменты не проходят «проверку», постарайтесь подобрать другие.
- 5) Сравните оценки Вашей регрессии с помощью МНК и 2-х шагового МНК, используя на первом шаге выбранные Вами инструментальные переменные.
- 6) Оформите все в виде связного текста (не забыв вставить необходимые таблицы).

Сроки отсылки данных, текста и do-файла (или скрипта) учебному ассистенту не позднее 23-59 (время) 7 марта 2021.